

# 国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金

## 2018 年第 4 季度报告

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年一月十九日

## § 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2019 年 1 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2018 年 10 月 11 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                               |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 国泰嘉睿纯债债券                                                                                                                      |
| 基金主代码      | 006475                                                                                                                        |
| 交易代码       | 006475                                                                                                                        |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                        |
| 基金合同生效日    | 2018 年 10 月 11 日                                                                                                              |
| 报告期末基金份额总额 | 3,991,538,169.33 份                                                                                                            |
| 投资目标       | 在注重风险和流动性管理的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。                                                                                            |
| 投资策略       | 本基金在债券投资中将根据对经济周期和市场环境的把握，基于对财政政策、货币政策的深入分析以及对宏观经济的持续跟踪，灵活运用久期策略、收益率曲线策略、类属配置策略、利率品种策略、信用债策略、回购套利策略、资产支持证券投资策略、中小企业私募债投资策略等多种 |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | <p>投资策略，构建债券资产组合，并根据对债券收益率曲线形态、息差变化的预测，动态地对债券投资组合进行调整。</p> <p>1、久期策略</p> <p>本基金将基于对宏观经济政策的分析，积极地预测未来利率变化趋势，并根据预测确定相应的久期目标，调整债券组合的久期配置，以达到提高债券组合收益、降低债券组合利率风险的目的。当预期市场利率水平将上升时，本基金将适当降低组合久期；而预期市场利率将下降时，则适当提高组合久期。在确定债券组合久期的过程中，本基金将在判断市场利率波动趋势的基础上，根据债券市场收益率曲线的当前形态，通过合理假设下的情景分析和压力测试，最后确定最优的债券组合久期。</p> <p>2、收益率曲线策略</p> <p>在组合的久期配置确定以后，本基金将通过对收益率曲线的研究，分析和预测收益率曲线可能发生的形状变化，采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。</p> <p>3、类属配置策略</p> <p>本基金对不同类型债券的信用风险、税负水平、市场流动性、市场风险等因素进行分析，研究同期限的国债、金融债、企业债、交易所和银行间市场投资品种的利差和变化趋势，制定债券类属配置策略，以获取不同债券类属之间利差变化所带来的投资收益。</p> <p>4、利率品种策略</p> <p>本基金对国债、央行票据等利率品种的投资，是在对国内、国外经济趋势进行分析和预测基础上，运用数量方法对利率期限结构变化趋势和债券市场供求关系变化进行分析和预测，深入分析利率品种的收益和风险，并据此调整债</p> |
|--|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|        |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                  |
|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|        | <p>券组合的平均久期。在确定组合平均久期后，本基金对债券的期限结构进行分析，运用统计和数量分析技术，选择合适的期限结构的配置策略，在合理控制风险的前提下，综合考虑组合的流动性，决定投资品种。</p> <p>5、信用债策略</p> <p>本基金将通过分析宏观经济周期、市场资金结构和流向、信用利差的历史水平等因素，判断当前信用债市场信用利差的合理性、相对投资价值和风险以及信用利差曲线的未来走势，确定信用债券的配置。</p> <p>6、回购套利策略</p> <p>回购套利策略也是本基金重要的投资策略之一，把信用债投资和回购交易结合起来，在信用风险和流动性风险可控的前提下，或者通过回购融资来博取超额收益，或者通过回购的不断滚动来套取信用债收益率和资金成本的利差。</p> <p>7、资产支持证券投资策略</p> <p>本基金将重点对市场利率、发行条款、支持资产的构成及质量、提前偿还率、风险补偿收益和市场流动性等影响资产支持证券价值的因素进行分析，并辅助采用蒙特卡洛方法等数量化定价模型，评估资产支持证券的相对投资价值并做出相应的投资决策。</p> <p>8、中小企业私募债投资策略</p> <p>本基金在严格控制风险的前提下，综合考虑中小企业私募债的安全性、收益性和流动性等特征，选择具有相对优势的品种，在严格遵守法律法规和基金合同基础上，谨慎进行中小企业私募债券的投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证综合债指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                       |
| 风险收益特征 | <p>本基金为债券型基金，预期收益和预期风险高于货币市场基金，但低于混合型基金、股票型基金，属于较低预期风险和预期收益的产品。</p>                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |

|       |            |
|-------|------------|
| 基金管理人 | 国泰基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 交通银行股份有限公司 |

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标          | 报告期<br>(2018 年 10 月 11 日 (基金合同生效日) - 2018 年 12 月 31 日) |
|-----------------|--------------------------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益      | 19,927,918.35                                          |
| 2. 本期利润         | 34,574,063.64                                          |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0124                                                 |
| 4. 期末基金资产净值     | 4,034,617,728.37                                       |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0108                                                 |

注：(1) 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

(2) 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

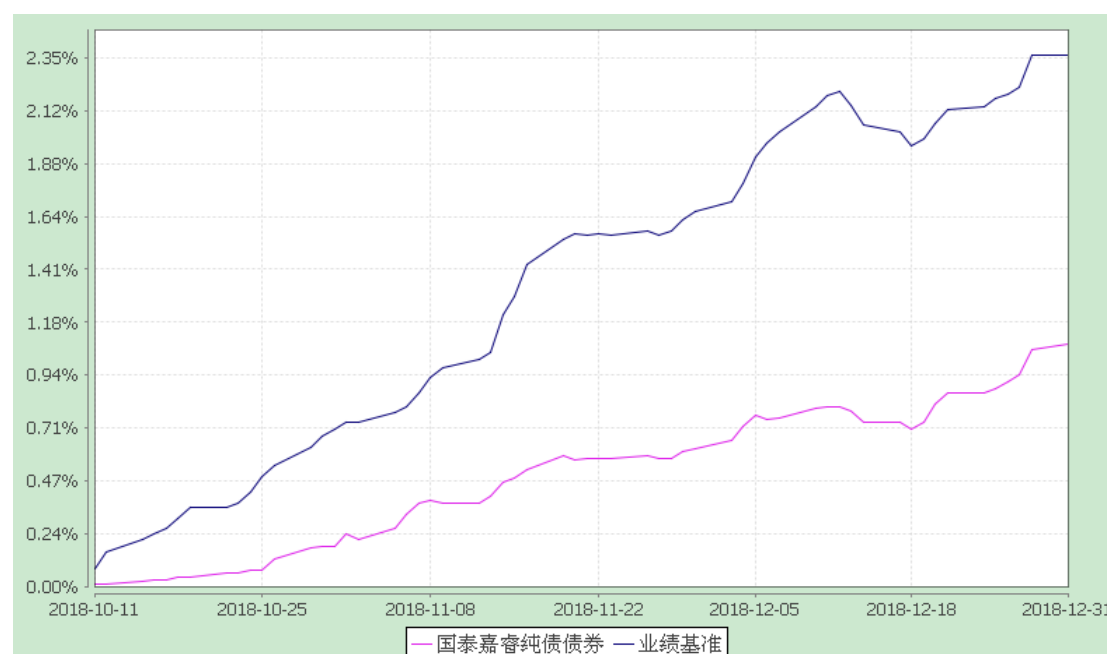
#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段                                            | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③    | ②-④    |
|-----------------------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|--------|--------|
| 2018 年 10 月 11 日 (基金合同生效日) 至 2018 年 12 月 31 日 | 1.08%  | 0.03%     | 2.36%      | 0.05%         | -1.28% | -0.02% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金  
累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2018 年 10 月 11 日至 2018 年 12 月 31 日)



注：（1）本基金合同生效日为2018年10月11日，截止至2018年12月31日，本基金运作时间未满一年；

（2）本基金的建仓期为6个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在6个月建仓结束时，确保各项资产配置比例符合合同约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

| 姓名  | 职务     | 任本基金的基金经理期限 |      | 证券从业年限 | 说明                                 |
|-----|--------|-------------|------|--------|------------------------------------|
|     |        | 任职日期        | 离任日期 |        |                                    |
| 黄志翔 | 本基金的基金 | 2018-08-30  | -    | 8 年    | 学士。2010 年 7 月至 2013 年 6 月在华泰柏瑞基金管理 |

|  |                                                                                                                                                                                                                                                                                 |  |  |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                              |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|  | 经理、<br>国泰民<br>丰回报<br>定期开<br>放灵活<br>配置混<br>合、国<br>泰润利<br>纯债债<br>券、国<br>泰润鑫<br>纯债、<br>国泰瞬<br>利货币<br>ETF、上<br>证 10<br>年期国<br>债<br>ETF、国<br>泰民安<br>增益纯<br>债债<br>券、国<br>泰瑞和<br>纯债债<br>券、国<br>泰聚禾<br>纯债债<br>券、国<br>泰丰祺<br>纯债债<br>券、国<br>泰聚享<br>纯债债<br>券、国<br>泰丰盈<br>纯债债<br>券的基<br>金经理 |  |  | 有限公司任交易员。2013 年 6 月加入国泰基金管理有<br>限公司，历任交易员和基金<br>经理助理。2016 年 11 月至<br>2017 年 12 月任国泰淘金互<br>联网债券型证券投资基金的<br>基金经理，2016 年 11 月<br>至 2018 年 5 月任国泰信用<br>债券型证券投资基金的基<br>金经理，2017 年 3 月起兼任<br>国泰润利纯债债券型证券<br>投资基金的基金经理，2017<br>年 3 月至 2017 年 10 月兼任<br>国泰现金宝货币市场基金<br>的基金经理，2017 年 4 月起<br>兼任国泰民丰回报定期开<br>放灵活配置混合型证券投资<br>基金的基金经理，2017<br>年 7 月起兼任国泰润鑫纯债<br>债券型证券投资基金的基<br>金经理，2017 年 8 月起兼任<br>国泰瞬利交易型货币市场<br>基金和上证 10 年期国债交<br>易型开放式指数证券投资<br>基金的基金经理，2017 年 9<br>月至 2018 年 8 月任国泰民<br>安增益定期开放灵活配置<br>混合型证券投资基金的基<br>金经理，2018 年 2 月至 2018<br>年 8 月任国泰安惠收益定期<br>开放债券型证券投资基金<br>的基金经理，2018 年 8 月起<br>兼任国泰民安增益纯债债<br>券型证券投资基金（由国泰<br>民安增益定期开放灵活配<br>置混合型证券投资基金转<br>型而来）、国泰瑞和纯债债<br>券型证券投资基金的基<br>金经理，2018 年 10 月起兼任<br>国泰嘉睿纯债债券型证券<br>投资基金的基金经理，2018<br>年 11 月起兼任国泰聚禾纯<br>债债券型证券投资基金和<br>国泰丰祺纯债债券型证券 |
|--|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|--|--|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|

|  |  |  |  |  |                                                               |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------|
|  |  |  |  |  | 投资基金的基金经理，2018 年 12 月起兼任国泰聚享纯债债券型证券投资基金和国泰丰盈纯债债券型证券投资基金的基金经理。 |
|--|--|--|--|--|---------------------------------------------------------------|

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理小组保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018 年 10 月，央行降准带动资金面宽松叠加金融及经济数据不及预期，债券市场收益率小幅下行；11 月初，民企座谈会召开叠加贸易战预期缓和，市场风险偏好提升，权益市场反弹，债券市场收益率出现较大幅度上行；继而在资金面保持宽松，基本面预期走弱的带动下，收益率小幅下行；11 月 13 日，10 月金融数据公布，社融及信贷数据跳水，带动债券市场收益率快速下行；12 月中旬，受《关于支持优质企业直接融资进一步增强企业债券服务实体经济能力的通知》发布影响，市场预期房地产融资将有所放松，风险偏好回升，收益率调整；12 月下旬，在美债收益率回落，国内央行货币宽松预期加强，12 月制造业 PMI 跌破荣枯线推动下，收益率重回下行通道。全季来看，债券收益率下行明显，基本面走弱带动长端下行大于短端，期限利差收窄。

四季度管理人适当拉长了久期，同时由于资金面较为宽松，套息策略依旧有效，组合一直维持较高杠杆。展望 2019 年初，管理人继续维持较高杠杆，持仓依旧以高等级信用债为主，同时积极参与中长端利率债波段操作，并根据市场情况逐步拉长信用债久期。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金在 2018 年第四季度的净值增长率为 1.08%，同期业绩比较基准收益率为 2.36%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，我们认为基本面对债券市场仍旧构成利好支撑。第一，经济下行压力在加大。首先，房地产住而不炒、居民债务高企、棚改力度降低预计将继续施压房地产投资，企业盈利下滑将制约投资扩张意愿，制造业增速料将回落，而基建投资虽有改善，但于投资仍独木难支。其次，2018 年 11 月社零创 2003 年以后新低，未来居民收入增长放缓，地产财富效应下降，预示着消费仍有较大下行压力。再者，全球经济放缓，外需疲弱将拖累出口，尤其在中美贸易冲突下 2018 年抢出口效应明显，对 2019 年出口或已形成一定透支。第二，宽货币向宽信用传导见效缓慢。尽管 2018 年 11 月以来，多项支持民营企业相关政策陆续落地，部分民营企业的股权质押风险得到了一定化解，但 2018 年 11 月工业企业盈利增速转负，可能制约风险偏好回升的脚步，宽信用见效仍需时间。综上，在经济增长放缓、民企融资困难的背景下，金融去杠杆和实体去杠杆并不是当前的主要目标，预计 2019 年货币政策将加强逆周期调控，宽松货币环境对债市仍构成支撑。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

无。

### § 5 投资组合报告

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目                | 金额(元)            | 占基金总资产的比例(%) |
|----|-------------------|------------------|--------------|
| 1  | 权益投资              | —                | —            |
|    | 其中：股票             | —                | —            |
| 2  | 固定收益投资            | 3,854,650,612.40 | 95.51        |
|    | 其中：债券             | 3,854,650,612.40 | 95.51        |
|    | 资产支持证券            | —                | —            |
| 3  | 贵金属投资             | —                | —            |
| 4  | 金融衍生品投资           | —                | —            |
| 5  | 买入返售金融资产          | 115,056,412.58   | 2.85         |
|    | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | —                | —            |
| 6  | 银行存款和结算备付金合计      | 441,380.70       | 0.01         |
| 7  | 其他各项资产            | 65,900,030.47    | 1.63         |
| 8  | 合计                | 4,036,048,436.15 | 100.00       |

#### 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

#### 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|------------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | -                | -            |
| 2  | 央行票据      | -                | -            |
| 3  | 金融债券      | 3,583,011,612.40 | 88.81        |
|    | 其中：政策性金融债 | 2,989,974,612.40 | 74.11        |
| 4  | 企业债券      | -                | -            |
| 5  | 企业短期融资券   | -                | -            |
| 6  | 中期票据      | -                | -            |
| 7  | 可转债（可交换债） | -                | -            |
| 8  | 同业存单      | 271,639,000.00   | 6.73         |
| 9  | 其他        | -                | -            |
| 10 | 合计        | 3,854,650,612.40 | 95.54        |

#### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称     | 数量(张)     | 公允价值(元)        | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|----------|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 170209 | 17 国开 09 | 6,900,000 | 700,695,000.00 | 17.37        |
| 2  | 180208 | 18 国开 08 | 4,600,000 | 468,418,000.00 | 11.61        |
| 3  | 180313 | 18 进出 13 | 4,300,000 | 434,558,000.00 | 10.77        |
| 4  | 160411 | 16 农发 11 | 2,600,000 | 259,194,000.00 | 6.42         |
| 5  | 170205 | 17 国开 05 | 2,500,000 | 252,550,000.00 | 6.26         |

#### 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

## 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。若本基金投资股指期货，本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。

本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

本基金管理人将充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，以降低投资组合的整体风险。

法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

5.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)         |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | 4,038.43      |
| 2  | 应收证券清算款 | —             |
| 3  | 应收股利    | —             |
| 4  | 应收利息    | 65,895,992.04 |
| 5  | 应收申购款   | —             |
| 6  | 其他应收款   | —             |
| 7  | 待摊费用    | —             |
| 8  | 其他      | —             |
| 9  | 合计      | 65,900,030.47 |

#### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

### § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                         |                  |
|-------------------------|------------------|
| 基金合同生效日基金份额总额           | 200,001,716.57   |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额   | 3,791,536,492.64 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 39.88            |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额  | —                |
| 本报告期期末基金份额总额            | 3,991,538,169.33 |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内本基金管理人未运用固有资金投资本基金。截至本报告期末，本基金管理人未持有本基金。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别                                                         | 报告期内持有基金份额变化情况 |                         |      |                  |      | 报告期末持有基金情况       |        |
|---------------------------------------------------------------|----------------|-------------------------|------|------------------|------|------------------|--------|
|                                                               | 序号             | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间  | 期初份额 | 申购份额             | 赎回份额 | 持有份额             | 份额占比   |
| 机构                                                            | 1              | 2018年10月26日至2018年12月31日 | -    | 1,498,123,957.53 | -    | 1,498,123,957.53 | 37.53% |
|                                                               | 2              | 2018年10月11日至2018年11月5日  | -    | 499,685,220.35   | -    | 499,685,220.35   | 12.52% |
|                                                               | 3              | 2018年10月11日至2018年11月5日  | -    | 499,683,221.05   | -    | 499,683,221.05   | 12.52% |
|                                                               | 4              | 2018年10月11日至2018年10月25日 | -    | 99,963,025.18    | -    | 99,963,025.18    | 2.50%  |
|                                                               | 5              | 2018年10月11日至2018年10月25日 | -    | 49,999,000.00    | -    | 49,999,000.00    | 1.25%  |
| 产品特有风险                                                        |                |                         |      |                  |      |                  |        |
| 当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。 |                |                         |      |                  |      |                  |        |

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金注册的批复
- 2、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金基金合同
- 3、国泰嘉睿纯债债券型证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

## 9.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 16 层-19 层。

## 9.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司  
二〇一九年一月十九日